

BANCO CENTRAL DE RESERVA DEL PERU
RESUMEN DE OPERACIONES MONETARIAS Y CAMBIARIAS
(Millones de Soles)

	09 Enero 17	10 Enero 17	11 Enero 17	12 Enero 17	13 Enero 17
1. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias antes de las operaciones del BCRP	4,298.4	4,800.8	5,811.2	6,904.2	6,587.7
2. Operaciones monetarias y cambiarias del BCR antes del cierre de operaciones					
a. Operaciones monetarias anunciadas del BCR					
i. Subasta de Certificados de Depósitos del BCRP (CD BCRP)					
Propuestas recibidas	30.0		30.0	200.0	200.0
Plazo de vencimiento	213.0		157.0	220.0	200.0
Tasas de interés	185.4		547.4	371.0	89.4
Máxima	4.22		4.54	4.45	4.30
Promedio	4.42		4.75	4.36	4.45
Saldo	4.35		4.70	4.45	4.33
Próximo vencimiento de CD BCRP el 09 de febrero de 2017	23,241.0	23,241.0	23,371.0	22,581.0	22,981.0
Vencimiento de CD BCRP del 16 al 20 de enero, 2017	1,220.0		1,220.0		0.0
ii. Subasta de Compra Temporal de Valores (REPO)					
Propuestas recibidas	399.0		399.0		399.0
Plazo de vencimiento	0.0		0.0		0.0
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,199.0	1,199.0	1,199.0	1,199.0	1,199.0
Próximo vencimiento de Repo de Valores el 08 de mayo de 2017	399.0		399.0		399.0
Vencimiento de REPO BCRP del 16 al 20 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
iii. Subasta de Compra Temporal de Valores (Repo Especial - CDR)					
Propuestas recibidas	0.0		0.0		0.0
Plazo de vencimiento	0.0		0.0		0.0
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Repo Especial - CDR	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de Repo Especial - CDR del 16 al 20 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
iv. Subasta de Certificados de Depósitos variables del BCR (CDV BCRP)					
Propuestas recibidas	0.0		0.0		0.0
Plazo de vencimiento	0.0		0.0		0.0
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de CDV BCRP el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de CDV BCRP del 16 al 20 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
v. Subasta de Depósitos a Plazo en Moneda Nacional	300.0	649.9	262.0	1083.4	300.0
Propuestas recibidas	555.0	1340.8	262.0	1083.4	533.0
Plazo de vencimiento	7.4	1.0	7.4	1.0	7.4
Tasas de interés	4.16	3.85	3.81	3.76	4.18
Máxima	4.23	3.85	4.23	4.23	4.22
Promedio	4.20	3.79	4.21	4.19	4.20
Saldo	1,849.9	2,545.4	3,762.0	4,561.9	3,083.9
Próximo vencimiento de Depósitos a Plazo el 16 de enero 2017	649.9		2,600.0		2,022.0
Vencimiento de Depósitos a Plazo del 20 de enero, 2017	1,549.9		2,900.0		1,061.9
vi. Subasta de Colocación DP en M.N. del Tesoro Público					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,600.0	1,600.0	1,600.0	1,600.0	1,600.0
Próximo vencimiento de Coloc-TP el 08 de junio de 2017	300.1		300.1		300.1
Vencimiento de Coloc-TP del 16 al 20 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
vii. Subasta de Colocación DP en M.N. del Banco de la Nación					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Próximo vencimiento de Coloc-BN el	0.0		0.0		0.0
Vencimiento de Coloc - BN del 16 al 20 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
viii. Subasta de Certificados de Depósitos Reaustables del BCRP (ICDR BCRP)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	1,030.0	775.0	325.0	325.0	225.0
Próximo vencimiento de CDR BCRP el 03 de marzo de 2017	255.0		100.0		225.0
Vencimiento de CDR BCRP del 16 al 20 de enero, 2017	705.0		100.0		0.0
ix. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Regular)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	13,925.1	13,925.1	13,925.1	13,925.1	13,925.1
Próximo vencimiento de Repo Regular el 16 de Junio de 2017	400.0		400.0		400.0
Vencimiento de REPO del 16 al 20 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
x. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Expansión)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	7,900.0	7,900.0	7,900.0	7,900.0	7,900.0
Próximo vencimiento de Repo Expansión el 17 de Enero de 2017	300.0		300.0		300.0
Vencimiento de REPO Expansión del 16 al 20 de enero, 2017					
xi. Compra con compromiso de Recompra de moneda extranjera (Sustitución)					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	4,804.7	4,804.7	4,804.7	4,804.7	4,804.7
Próximo vencimiento de Repo Sustitución el 26 de Mayo de 2017	243.0		243.0		243.0
Vencimiento de REPO Sustitución del 16 al 20 de enero, 2017	0.0		0.0		0.0
xii. Subasta de Swaps Cambiario Venta del BCRP					
Propuestas recibidas					
Plazo de vencimiento					
Tasas de interés					
Máxima					
Promedio					
Saldo	513.5	403.2	114.0	114.0	114.0
Próximo vencimiento de SC Venta el 08 de febrero 2017	110.3		100.0		100.0
Vencimiento de SC - Venta del 16 al 20 de enero, 2017	399.5		0.0		0.0
b. Operaciones cambiarias en la Mesa de Neociación del BCR					
i. Compras (millones de US\$)	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
- Tipo de cambio promedio					
ii. Ventas (millones de US\$)					
- Tipo de cambio promedio					
c. Operaciones con el Tesoro Público (millones de US\$)					
i. Compras (millones de US\$) - Tesoro Público					
ii. Ventas (millones de US\$) - Tesoro Público					
d. Operaciones en el Mercado Secundario de CD BCRP, CD BCRP-NR y BTP					
i. Compras de CD BCRP y CD BCRP-NR	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
ii. Compras de BTP					
3. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR antes del cierre de operaciones	3,318.5	3,455.4	3,081.2	3,074.3	4,165.7
4. Operaciones monetarias del BCR para el cierre de operaciones					
a. Compra temporal de moneda extranjera (Inversa)	0.0132%	0.0132%	0.0132%		0.0132%
Comisión (tasa efectiva diaria)					
b. Compra temporal directa de valores (fuera de subasta)					
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
c. Crédito por regularización monetaria en moneda nacional					
Tasa de interés	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%	4.80%
d. Depósitos Overnight en moneda nacional	232.5	174.0	2.9	300.0	2,010.0
Tasa de interés	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%
5. Saldo de la cuenta corriente de las empresas bancarias en el BCR al cierre de operaciones	3,086.0	3,281.4	3,079.3	2,724.3	2,155.7
a. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	0,091.0	0,133.0	0,035.9	0,058.2	0,046.0
b. Fondos de encaje en moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (%)	7.1	7.1	7.0	7.0	7.0
c. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (millones de S/)	3,156.9	3,132.0	3,127.1	3,140.7	3,065.0
d. Cuenta corriente moneda nacional promedio acumulado (% del TOSE) (%)	2.6	2.6	2.7	2.7	2.7
6. Mercado interbancario y mercado secundario de CDBCRP					
a. Operaciones a la vista en moneda nacional	1,488.0	1,241.0	713.0	526.0	451.0
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
b. Operaciones a la vista en moneda extranjera (millones de US\$)	4,254,254.25	4,254,254.25	4,254,254.25	4,204,254.25	4,204,254.25
Tasas de interés: Mínima / Máxima / Promedio					
c. Total mercado secundario de CDBCRP, CDBCRP-NR y CDV	142.0	40.0	20.0	0.0/0.60/0.60	0.60/0.60/0.60
Plazo 6 meses (monto / tasa promedio)				5.0	5.0
Plazo 12 meses (monto / tasa promedio)	12.0/ 4.40			5.0/ 4.40	5.0/ 4.40
7. Operaciones en moneda extranjera de las empresas bancarias (millones de US\$)	06 enero 17	09 enero 17	10 enero 17	11 enero 17	12 enero 17
Flujo de la posición global = a + b - c + e + f + g	152.9	1.3	-131.6	-14.2	66.7
Flujo de la posición contable = a + b - c + e + f + g	10.6	7.1	-122.5	-5.7	-5.7
a. Mercado spot con el público	-30.9	4.5	-6.2	83.2	0.7
i. Compras	206.7	181.4	189.4	551.2	564.8
ii. (-) Ventas	237.6	177.0	195.6	468.1	569.9
b. Compras forward al público (con y sin entrega)	-224.5	-16.6	-30.3	-12.8	101.4
i. Pasadas	206.4	89.2	173.7	134.4	231.5
ii. (-) Ventas	101.8	104.8	194.0	147.1	130.1
c. Ventas forward al público (con y sin entrega)	82.0	-9.4	-32.4	-57.2	7.5
i. Pasadas	117.3	69.8	75.3	88.8	211.7
ii. (-) Ventadas	35.3	103.2	137.6	126.0	204.2
d. Operaciones cambiarias interbancarias					
i. Al contado	355.5	221.7	268.6	337.0	461.8
ii. A futuro	0.0	10.0	30.0	11.0	25.0
e. Operaciones spot asociadas a swaps y vencimientos de forwards sin entrega	-25.9	11.3	-67.6	54.7	76.0
i. Compras	27.2	102.2	102.9	125.9	201.6
ii. (-) Ventas	53.1	90.9	167.9	71.2	125.7
f. Efecto de Opciones	-0.2	0.3	0.7	0.1	-21.5
g. Operaciones netas con otras instituciones financieras	0.9	-10.3	-117.5	-217.8	-8.3
h. Crédito por regularización monetaria en moneda extranjera					
Tasa de interés					
Nota: Tipo de cambio interbancario promedio (Fuente: Database)	3,374.1	3,381.7	3,388.7	3,390.9	3,391.3